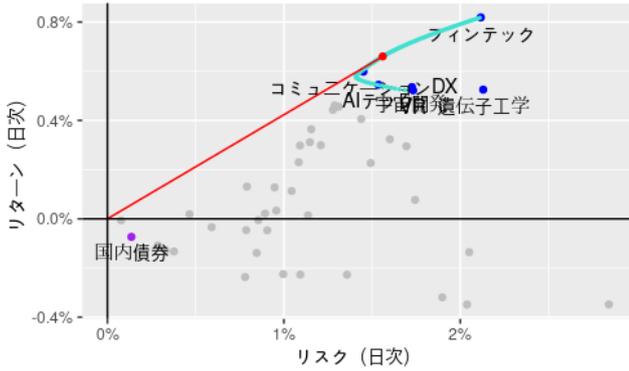


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

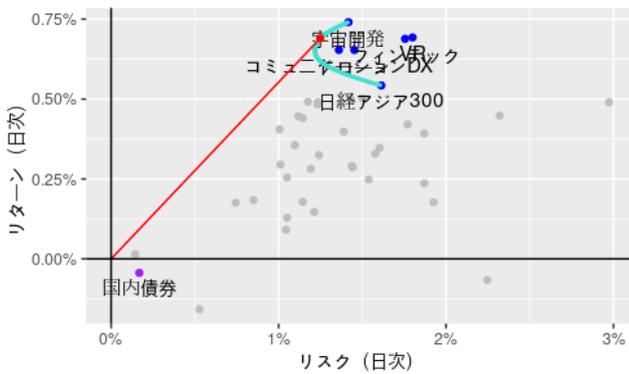
2024年10月19日

【半月】



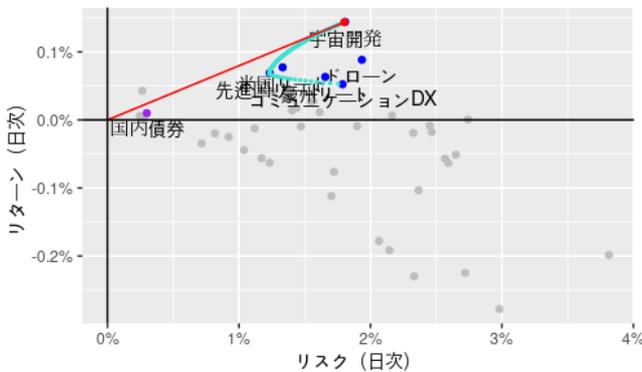
| eMAXIS | リターン | リスク | t 値 | 割合 |
|--------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.660% | 1.560% | 0.423 | — |
| フィンテック | 0.819% | 2.116% | 0.387 | 28.0% |
| コミュニケーション DX | 0.599% | 1.451% | 0.412 | 72.0% |
| AI テック | 0.545% | 1.536% | 0.355 | 0.0% |
| 宇宙開発 | 0.536% | 1.726% | 0.310 | 0.0% |
| 遺伝子工学 | 0.525% | 2.130% | 0.247 | 0.0% |
| VR | 0.522% | 1.732% | 0.302 | 0.0% |

【一ヶ月】



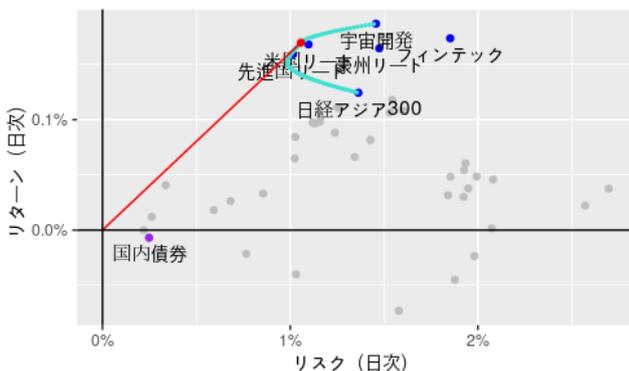
| eMAXIS | リターン | リスク | t 値 | 割合 |
|--------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.690% | 1.249% | 0.553 | — |
| 宇宙開発 | 0.741% | 1.418% | 0.522 | 41.9% |
| VR | 0.693% | 1.800% | 0.385 | 0.0% |
| フィンテック | 0.688% | 1.756% | 0.392 | 0.0% |
| コミュニケーション DX | 0.654% | 1.360% | 0.481 | 33.0% |
| ドローン | 0.653% | 1.453% | 0.450 | 25.1% |
| 日経アジア 300 | 0.542% | 1.613% | 0.336 | 0.0% |

【四半期】



| eMAXIS | リターン | リスク | t 値 | 割合 |
|--------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.143% | 1.802% | 0.080 | — |
| 宇宙開発 | 0.144% | 1.808% | 0.080 | 99.3% |
| ドローン | 0.088% | 1.935% | 0.046 | 0.0% |
| 米国リート | 0.077% | 1.333% | 0.058 | 0.7% |
| 先進国リート | 0.069% | 1.234% | 0.056 | 0.0% |
| 豪州リート | 0.063% | 1.656% | 0.038 | 0.0% |
| コミュニケーション DX | 0.052% | 1.788% | 0.029 | 0.0% |

【半年】

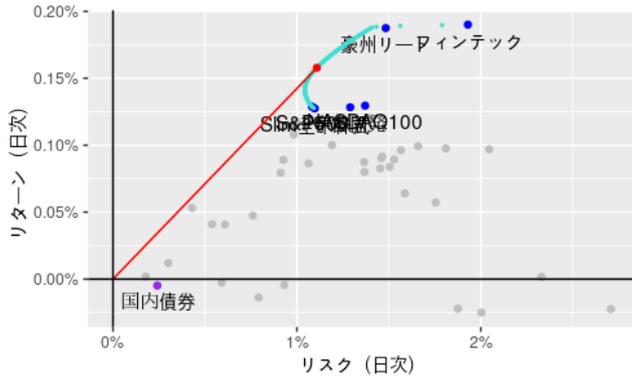


| eMAXIS | リターン | リスク | t 値 | 割合 |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.170% | 1.057% | 0.161 | — |
| 宇宙開発 | 0.187% | 1.457% | 0.128 | 12.4% |
| フィンテック | 0.174% | 1.852% | 0.094 | 0.0% |
| 米国リート | 0.168% | 1.098% | 0.153 | 67.4% |
| 豪州リート | 0.165% | 1.474% | 0.112 | 20.2% |
| 先進国リート | 0.159% | 1.014% | 0.157 | 0.0% |
| 日経アジア 300 | 0.124% | 1.363% | 0.091 | 0.0% |

備考 (1) グラフ中の赤点 (・) は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。

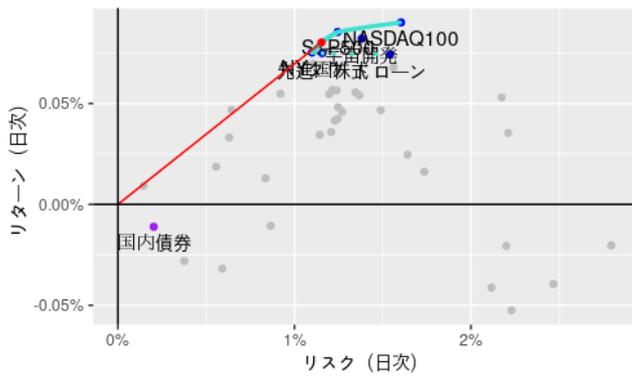
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



| eMAXIS | リターン | リスク | t 値 | 割合 |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.158% | 1.109% | 0.142 | — |
| フィンテック | 0.190% | 1.930% | 0.098 | 2.9% |
| 豪州リート | 0.187% | 1.483% | 0.126 | 46.5% |
| NASDAQ100 | 0.130% | 1.371% | 0.094 | 0.0% |
| S&P500 | 0.129% | 1.082% | 0.119 | 50.6% |
| 宇宙開発 | 0.128% | 1.290% | 0.100 | 0.0% |
| Slim 全米株式 | 0.127% | 1.097% | 0.116 | 0.0% |

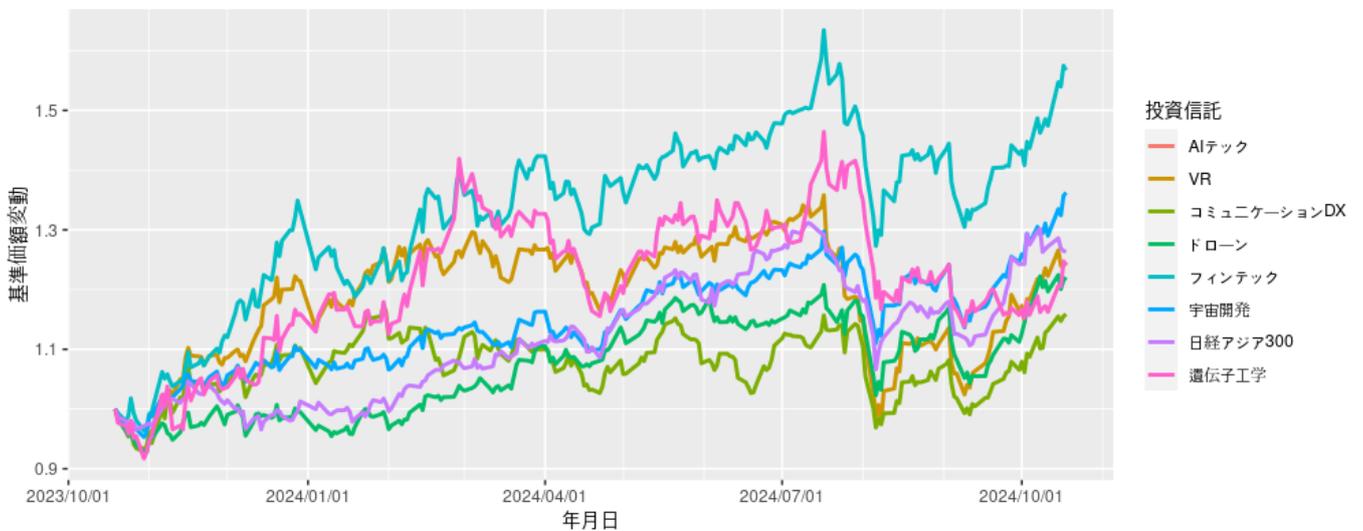
【三年】



| eMAXIS | リターン | リスク | t 値 | 割合 |
|------------|--------|--------|-------|-------|
| 効率的ポートフォリオ | 0.080% | 1.153% | 0.070 | — |
| NASDAQ100 | 0.090% | 1.604% | 0.056 | 0.0% |
| S&P500 | 0.085% | 1.245% | 0.069 | 49.4% |
| 宇宙開発 | 0.082% | 1.381% | 0.059 | 0.0% |
| NY ダウ | 0.075% | 1.099% | 0.068 | 50.6% |
| 先進国株式 | 0.075% | 1.157% | 0.065 | 0.0% |
| ドローン | 0.074% | 1.542% | 0.048 | 0.0% |

備考 (1) グラフ中の赤点 (・) は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。
 (2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

eMAXIS シリーズでリターンが高かった銘柄の基準価額の変動



備考 直近半月と一ヶ月でリターン上位の銘柄について一年前を 1 として直近一年間の価額変動を示す。